

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2019

Fecha de Información: 23 de mayo de 2019 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2053.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.²

Cuadro No. 1							
Contratos Forwards Pactados							
Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	329.1	129.4	51.2	257.2	46.1	39.8	32.1
15-35	487.8	676.3	507.5	154.3	58.4	223.1	110.5
36-60	62.5	115.3	0.0	0.0	115.3	62.5	0.0
61-90	61.0	119.1	50.0	0.0	19.1	11.0	50.0
91-180	125.1	100.5	30.0	65.0	30.5	20.1	40.0
>180	69.7	45.5	10.0	18.3	0.3	16.3	35.2
Total	1135.3	1186.1	648.7	494.7	269.7	372.8	267.8

* Cifras en millones de dólares
** Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes
*** Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2					
Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada					
Rango	Sector Financiero*		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	2.2 %		2.5 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.2 %		2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	-		2.2 %	2.0 %	2.2 %
61-90	2.1 %		1.9 %	1.9 %	1.9 %
91-180	2.0 %		2.0 %	1.9 %	1.9 %
>180	2.0 %		2.2 %	1.5 %	1.9 %
Total	2.1 %		2.2 %	2.1 %	2.1 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3												
Vencimientos de Forwards												
Sectores	20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	151	5871	5879	21	177	3246	3581	28	84	3334	4035
Intragrupo y off-shore***	0	0	3363	2727	0	0	1784	1049	0	0	2215	996
Otros	151	39	1006	1633	177	21	1006	1406	84	28	702	1219
Total	190	190	10240	10240	198	198	6036	6036	112	112	6251	6251

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.
** Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes
*** Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.
² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.